

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2012

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.349.401.704,00		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			919.763.433,79	68,16	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		164.903	397.126.836,38	29,43	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			253.626.488,88	18,80	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		27,00	170.484.329,98	12,63	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	41.568.148,58	3,08	3,08
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	805.700,63	0,06	0,06
. CDB 182 DIAS - BVA	PÓS	3	851.538,16	0,06	0,06
. CDB 181 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	32.742,34	0,00	
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	14.069,78	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	60.477.162,53	4,48	4,48
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	16.146.511,66	1,20	1,20
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	16.326.401,98	1,21	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	8.421.642,56	0,62	1,83
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,40	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,40	0,81
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	10.915.830,86	0,81	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	748.798,20	0,06	0,86
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.628.228,88	0,27	0,27
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	10.547.553,82	0,78	0,78
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		-4	-10.884.285,63	-0,81	-0,81
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		35	13.093.331,72	0,97	
. PINE		17	6.112.905,44	0,45	0,45
. ABC		17	6.431.425,82	0,48	0,48
. BONSUCESSO		1	549.000,46	0,04	0,04
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		22.439.620,23	70.048.827,18	5,19	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	47.401,17	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		1.597.085,80	9.586.432,99	0,71	0,71
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	9.781,75	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		5.234.916,70	8.130.491,01	0,60	0,60
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.669,06	0,00	0,00
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	6.120.598,83	0,45	0,45
. BTG PACTUAL		3.708.924,99	4.363.173,44	0,32	0,32
. SAFRA INSTITUCIONAL		47.277,51	8.868.793,73	0,66	0,66
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	3.665.176,08	0,27	0,27
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,99	3.034.596,13	0,22	0,22
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.723,99	8.390.534,08	0,62	0,62
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	5.418.297,12	0,40	0,40
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		11.809.150,31	12.211.325,71	0,90	0,90
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I		2,00	200.556,08	0,01	0,01
<u>Debêntures</u>		25.669	70.497.367,48	5,22	
. CPFL ENERGIA		1.101	11.271.561,54	0,84	0,84
. ELETROMETRÔ		10.248	4.942.846,91	0,37	0,37
. PETROBRÁS		1.760	4.151.860,27	0,31	0,31
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.258.923,73	0,46	0,46
. ECOPISTAS		7.000	8.166.053,51	0,61	0,61
. COMANCHE PART.		5.000	6.265.970,10	0,46	0,46
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	29.440.151,42	2,18	2,18

<u>Outros Títulos</u>		<u>25.535</u>	<u>198.512.741,05</u>	<u>14,71</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		67	21.033.521,73	1,56	1,56
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		16	27.189.552,84	2,01	2,01
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	118.527.278,37	8,78	8,78
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		25.449	31.421.022,29	2,33	2,33
. VALORES A RECEBER			915.478,17	0,07	0,07
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-574.112,35	-0,04	-0,04
<u>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</u>			<u>212.580.259,62</u>	<u>15,75</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>100.115.563,62</u>	<u>7,42</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>8.898.645</u>	<u>84.892.871,14</u>	<u>6,29</u>	
. ALL AMER LAT	ON	253.178	2.146.949,44	0,16	
. AMBEV	DIR	28	2.164,40	0,00	
. AMBEV	PN	11.740	907.502,00	0,07	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	143.350	4.356.406,50	0,32	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	62.700	1.442.100,00	0,11	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	326.100	3.342.525,00	0,25	
. COPEL	PNB	48.170	2.129.114,00	0,16	
. ECORODOVIAS	ON	55.900	903.903,00	0,07	
. ELETROBRÁS	ON	144.677	2.061.647,25	0,15	
. GAFISA	ON	122.800	322.964,00	0,02	
. GERDAU - GGBR	PN	129.878	2.298.840,60	0,17	
. HYPERMARCAS	ON	118.300	1.404.221,00	0,10	
. ISHARES	CI	85.000	4.540.700,00	0,34	
. ITAUSA	PN	690.450	5.868.825,00	0,43	
. MARCOPOLO	PN	71.000	642.550,00	0,05	
. MARFRIG	ON	131.900	1.231.946,00	0,09	
. LOCALIZA	ON	34.200	1.037.970,00	0,08	
. OGX PETRÓLEO	ON	270.100	1.485.550,00	0,11	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	37.679	3.014.320,00	0,22	
. PDG REALT	ON	1.090.134	2.929.916,34	0,22	
. PETROBRÁS	PN	1.000.859	18.265.676,75	1,35	
. POSITIVO INF	ON	83.500	470.105,00	0,03	
. RANDON PART	PN	107.450	967.050,00	0,07	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	138.742	1.578.883,96	0,12	
. SUZANO PAPEL	PNA	56.050	222.518,50	0,02	
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	0,65	
. TELEF. BRASIL - VIVT	PN	21.908	1.094.961,84	0,08	
. TIM PART S/A	ON	44.192	493.182,72	0,04	
. TRACTEBEL	ON	37.000	1.374.550,00	0,10	
. USIMINAS	PNA	244.900	1.547.768,00	0,11	
. V-AGRO	ON	1.787.900	679.402,00	0,05	
. VALE R. DOCE	ON	1.000	40.130,00	0,00	
. VALE R. DOCE	PNA	247.860	9.706.197,60	0,72	
. VALORES A PAGAR (-)			-2.627.225,67	-0,19	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			286.555,91	0,02	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>596.165</u>	<u>15.222.692,48</u>	<u>1,13</u>	
. BRADESCO	PN	60.313	1.805.771,22	0,13	
. BRASIL	ON	208.052	4.063.255,56	0,30	
. ITAU	PN	327.800	9.273.462,00	0,69	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			80.203,70	0,01	
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>-595.700</u>	<u>-293.967,00</u>	<u>-0,02</u>	
. BMF BOVESPA	ON	-162.000	-160.380,00	-0,01	
. OGX PETROLEO	ON	-50.000	-500,00	0,00	
. PDG REALT	ON	-203.700	-103.887,00	-0,01	
. PETROBRAS	PN	-180.000	-29.200,00	0,00	
<u>B3. Fundos</u>		<u>18.485.554,56</u>	<u>112.758.663,00</u>	<u>8,36</u>	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		396.770,84	37.310.304,35	2,76	
. FATOR SINERGIA		15.105,99	22.774.672,49	1,69	
. GERAÇÃO FUTURO		13.079.083,45	19.165.631,12	1,42	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		161.800,50	16.584.841,91	1,23	
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		1.332.793,79	12.871.686,63	0,95	
. M. SQUARE PIPE FIA		3.499.999,99	4.051.526,50	0,30	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		170.546,94	62.233.200,49	4,61	
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.745,39	3.218.413,95	0,24	
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		7.510,64	5.983.007,05	0,44	
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.676,93	13.921.502,04	1,03	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		2.163,99	2.053.810,78	0,15	
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	1.749.799,86	0,13	
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	15.405.000,00	1,14	
. BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO		99.010,00	15.297.045,00	1,13	
. CLARITAS LOG ISTICA I FI IMOBILIARIO		440,00	4.413.426,49	0,33	
. VALORES A RECEBER			191.195,32	0,01	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			81.543.010,96	6,04	
D1 - Investimentos em Shopping Center			70.111.218,21	5,20	
. SHOPPING TATUAPE II			20.944.695,14	1,55	
. SHOPPING PLAZA SUL			27.463.825,30	2,04	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			21.151.994,69	1,57	
. VALORES A RECEBER			550.703,08	0,04	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	0,85	
. PANAMBY			12.144.487,33	0,90	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,05	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.508	69.550.509,04	5,15	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.508	69.193.406,35	5,13	
. VALORES A PAGAR (-)			-86.772,91	-0,01	
. VALORES A RECEBER			443.875,60	0,03	
F - OUTROS			3.731.290,10	0,29	
. DISPONIVEL			3.939.998,86	0,29	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			1.139.274,82	0,08	
. OUTROS REALIZAVEIS			514.427,06	0,04	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-949.921,79	-0,07	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-912.488,85	-0,07	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	37.310.304,35	15,23%	2,76%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	47.401,17	0,02%	0,00%
- BNP PARIBAS SMART	1.669,06	0,00%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	22.774.672,49	9,29%	1,69%
- GERAÇÃO FUTURO	19.165.631,12	7,82%	1,42%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	16.584.841,91	6,77%	1,23%
- BTG PACTUAL	4.363.173,44	1,78%	0,32%
- SAFRA INSTITUCIONAL	8.868.793,73	3,62%	0,66%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	12.871.686,63	5,25%	0,95%
- M. SQUARE PIPE FIA	4.051.526,50	1,65%	0,30%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	3.665.176,08	1,50%	0,27%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	3.034.596,13	1,24%	0,22%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	8.390.534,08	3,42%	0,62%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	5.418.297,12	2,21%	0,40%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	12.211.325,71	4,98%	0,90%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I	200.556,08	0,08%	0,01%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	6.120.598,83	2,50%	0,45%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	9.781,75	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	8.130.491,01	3,32%	0,60%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	9.586.432,99	3,91%	0,71%

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	3.218.413,95	1,31%	0,24%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.983.007,05	2,44%	0,44%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	13.921.502,04	5,68%	1,03%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	2.053.810,78	0,84%	0,15%
- MEMORIAL OFFICE FI MOBILIARIO	1.761.799,86	0,72%	0,13%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	15.501.720,00	6,33%	1,15%
- BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO	15.379.520,32	6,28%	1,14%
- CLARITAS LOG ISTICA I FI IMOBILIARIO	4.413.426,49	1,80%	0,33%
TOTAL	245.040.690,67	100,00%	18,16%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	849.714.606,61	76,94%	62,97%
RENDA VARIÁVEL	99.821.596,62	9,04%	7,40%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	81.543.010,96	7,38%	6,04%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	69.550.509,04	6,30%	5,15%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.731.290,10	0,34%	0,28%
TOTAL	1.104.361.013,33	100,00%	81,84%